

**KEMENTRIAN RISET, TEKNOLOGI DAN PERGURUAN TINGGI
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS UNIVERSITAS AIRLANGGA**

**PROGRAM STUDI : EKONOMI ISLAM
DAFTAR No. :**

**ABSTRAK
SKRIPSI SARJANA EKONOMI ISLAM**

NAMA: SARAH AULIA RAHMA
NIM : 041211433066
TAHUN PENYUSUNAN : 2016

JUDUL

“Kinerja Reksadana Saham Syariah, Reksadana Syariah Pendapatan Tetap dan Campuran, dan Pasar JII Dengan Menggunakan Metode Treynor (Periode 2011-2015)”

ISI:

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui ada tidaknya perbedaan kinerja reksadana saham syariah, reksadana syariah pendapatan tetap, reksadana syariah pendapatan campuran dan pasar Jakarta Islamic Index (JII) dengan menggunakan metode Treynor periode 2011-2015. Populasi dari penelitian ini adalah perusahaan reksadana saham syariah, perusahaan reksadana syariah pendapatan tetap, perusahaan reksadana syariah pendapatan campuran yang tercatat di OJK dan pasar JII. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data bulanan NAB reksadana syariah, Sertifikat Bank Indonesia Syariah (SBIS) sebagai *risk free* dan JII sebagai *risk market*. Pendekatan yang digunakan adalah pendekatan kuantitatif dengan menggunakan teknik analisis ANOVA yang hasilnya akan diinterpretasikan.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa perhitungan kinerja reksadana syariah dan pasar JII yang memiliki kinerja terbaik dengan menggunakan metode Treynor periode 2011-2015 adalah reksadana syariah pendapatan campuran dengan nilai -0,115. Berdasarkan uji ANOVA didapatkan hasil bahwa kinerja reksadana saham syariah, reksadana syariah pendapatan tetap, reksadana syariah pendapatan campuran dan pasar JII menggunakan metode Treynor periode 2011-2015 terbukti tidak memiliki perbedaan kinerja karena nilai signifikansinya $> 0,05$ yaitu sebesar 0,929.

Kata kunci: Reksadana Saham Syariah, Reksadana Syariah Pendapatan Tetap, Reksadana Syariah Pendapatan Campuran, Jakarta Islamic Index, Metode Treynor

**MINISTRY OF RESEARCH, TECHNOLOGY AND HIGHER EDUCATION
FACULTY OF ECONOMIC AND BUSINESS UNIVERSITAS AIRLANGGA**

STUDY :ISLAMIC ECONOMICS

No. LIST :

**ABSTRACT
THESIS OF ISLAMIC ECONOMICS BACHELOR**

NAME : SARAH AULIA RAHMA

NIM : 041211432037

YEARS OF PREPARATION : 2016

TITLE

:

The Performance of Sharia Mutual Fund Shares, Sharia Mutual Fixed Income, and Combined Income on The Stock Market of JII using Treynor Method (Period 2011 – 2015)

CONTENT :

The objective of this research is to identify whether there is a difference of the performance of Sharia Mutual Fund Shares, Sharia Mutual Fixed Income Shares, Sharia Mutual Fund Shares Combined, and The Market of Jakarta Islamic Index (JII) using Treynor Method period 2011 – 2015. Population of this research are the company of Sharia Mutual Fund Shares, the company of Sharia Mutual Fund Shares Fixed, the company of Sharia Mutual Fund Shares Combined written in OJK and market of JII. Data used in the research are NAB monthly data of sharia mutual fund shares, the certificate of Indonesian sharia Bank (SBIS) as risk free and JII as risk market. The approach used in this research is quantitative using ANOVA analysis technique that the results will be interpreted.

The result demonstrates that the calculation of the performance of sharia mutual fund shares and markets that have the greatest performance by using Treynor method is share mutual fund shares combined with -0,115 of its score. Based on ANOVA analysis technique, the results showed that the performance of sharia mutual fund shares, sharia mutual fund shares fixed, sharia mutual fund shares combined by using Treynor method (period 2011-2015) proved that there is no significant performance difference because the significance value > 0.05 is 0.929.

Keywords: sharia mutual fund shares, sharia mutual fund shares fixed, sharia mutual fund shares combined, Jakarta Islamic index, Treynor method